ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΠΕΙΡΑΙΩΣ
ΣΧΟΛΗ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΗΣ ΚΑΙ ΣΤΑΤΙΣΤΙΚΗΣ
ΤΜΗΜΑ ΣΤΑΤΙΣΤΙΚΗΣ
ΚΑΙ ΑΣΦΑΛΙΣΤΙΚΗΣ ΕΠΙΣΤΗΜΗΣ

UNIVERSITY OF PIRAEUS
SCHOOL OF FINANCE AND STATISTICS
DEPARTMENT OF
STATISTICS AND INSURANCE SCIENCE

ΠΡΟΣΚΛΗΣΗ ΣΕ ΔΙΑΛΕΞΗ

Την Τετάρτη 06/12/2017 στις 14:00 θα πραγματοποιηθεί διάλεξη στο Εργ. 006 στο ισόγειο του Κεντρικού Κτηρίου του Πανεπιστημίου Πειραιώς με ομιλήτρια την Υποψήφια Διδάκτορα κα Gema Pigueiras του Τμήματος Στατιστικής και Επιχειρησιακής Έρευνας του Πανεπιστημίου του Cadiz (Ισπανία), με θέμα:

“A new family of premium principles obtained by a risk-adjusted distribution”

Περίληψη

Risk-adjusted distributions are commonly used in actuarial science to define premium principles. In this work, que claim that an appropriate risk-adjusted distribution, besides of satisfying other desirable properties, should be well- behaved under conditioning with respect to the original risk distribution. Based on a sequence of such risk-adjusted distributions, we introduce a family of premium principles that gradually incorporate the degree of risk-aversion of the insurer in the safety loading. Member of this family are particular distortion premium principles that can be represented as mixtures of TVaRs, where the weights in the mixture reflect the attitude toward risk of the insurer. We make a systematic study of this family of premium principles.

Keywords: premium principle, risk measure, order statistics, distortion function.